

「JPX 日経インデックス 400」および「JPX 日経中小型株指数」の算出要領の改定について

株式会社日本経済新聞社および株式会社東京証券取引所が共同で算出を行う「JPX 日経インデックス 400」および「JPX 日経中小型株指数」について、2020年3月27日に公表した「配当落微調整日の早期化について」に基づき、算出要領を下記のとおり一部改定いたします。

【参考 URL】 https://indexes.nikkei.co.jp/nkave/archives/news/20200327J_2.pdf

記

1. 主な改定内容

配当落微調整日の変更

IV. 2. (2)b

※詳細は別添「新旧対照表」をご参照ください。

2. 改定日

2020年6月30日

(変更後初回の配当落微調整日となります。)

以上

別添：新旧対照表

改定後	改定前
<p>IV.基準時価総額の修正</p> <p>2. 修正方法</p> <p>(2) 配当込み指数</p> <p>b. 予想配当金と決算短信等で公表された配当金の差異による微調整</p> <ul style="list-style-type: none"> 配当落日に使用した予想配当金と、<u>決算短信又は剰余金の配当に関する開示（以下「決算短信等」という。）</u>で公表された配当金との間に差異が見られた銘柄について配当落金額の微調整を行う。具体的には、<u>決算短信等で配当金が公表される日（以下「公表日」という。）の月末営業日（ただし、公表日が月末営業日の前営業日又は月末営業日の場合においては、原則として翌月末営業日）</u>に、配当落微調整額の総額を算出し、基準時価総額の修正を行う。 <p><u>(削除)</u></p>	<p>IV.基準時価総額の修正</p> <p>2. 修正方法</p> <p>(2) 配当込み指数</p> <p>b. 予想配当金と決算短信で公表された配当金の差異による微調整</p> <ul style="list-style-type: none"> 配当落日に使用した予想配当金と、決算短信で公表された配当金との間に差異が見られた銘柄について配当落金額の微調整を行う。具体的には、<u>配当落日が属する月の3ヶ月後の月の7日（休業日の場合は前営業日に繰り上げる）</u>に、配当落微調整額の総額を算出し、基準時価総額の修正を行う。（例えば3月決算の場合、微調整の実施日は6月7日となる。） 配当落微調整処理の対象期間は、「配当落微調整実施日の3営業日前までに開示されている情報」を対象とする。ただし、上述の対象期間外に配当修正が開示され、その修正内容が指数値に影響を与える影響が大きいと算出者が判断した場合、追加で配当落微調整を実施する。

以上